



**UNIVERSIDADE FEDERAL DA PARAÍBA**  
**DEPARTAMENTO DE ESTATÍSTICA**  
**DISCIPLINA: Econometria**  
**PROFESSORA: Tarciana Liberal Pereira**



**Lista 01 - Heterocedasticidade**

1. Mostre o que acontece com as variâncias dos estimadores sob heterocedasticidade.
2. Considere um modelo de regressão com duas variáveis independentes ( $X_1$  e  $X_2$ ) e cuja variância do erro é proporcional a  $X_1 * X_2$ . Obtenha a equação de regressão transformada de forma que a variância do erro seja homocedástica. Qual parâmetro seria o intercepto na nova regressão?
3. Sobre Heterocedasticidade, responda:
  - (a) Liste os passos que devem ser feitos na presença de Heterocedasticidade.
  - (b) Qual método deve ser preferível MQG ou MQO com erros padrões robustos?
4. Questão 11.10 o livro Econometria de Hill, Judges e Griffiths.
5. Questões do livro: Econometria Básica (Gujarati).
  - 11.1, 11.2, 11.6, 11.8, 11.15, 11.16, 11.17, 11.20 e 11.22.